

OV1：リスク・アセットの概要

国際様式の 該当番号		イ		ロ		ハ		ニ	
		リスク・アセット				所要自己資本			
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	44,181,371	43,866,350	3,717,776	3,690,801				
2	うち、標準的手法適用分	2,797,587	2,758,016	223,806	220,641				
3	うち、内部格付手法適用分	38,180,552	37,811,087	3,237,710	3,206,380				
	うち、重要な出資のエクスポージャー	—	—	—	—				
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	45,567	50,138	3,645	4,011				
	その他	3,157,664	3,247,109	252,613	259,768				
4	カウンターパーティ信用リスク	4,822,842	5,087,487	392,354	413,750				
5	うち、SA-CCR適用分	—	—	—	—				
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	1,338,017	1,374,067	112,463	115,484				
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	—	—	—	—				
	うち、CVAリスク	2,549,322	2,977,943	203,945	238,235				
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	119,017	117,673	9,521	9,413				
	その他	816,484	617,803	66,423	50,616				
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	1,084,489	943,254	91,964	79,987				
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルク・スルー方式）	1,877,396	1,803,804	150,191	144,304				
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドート方式）	—	—	—	—				
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	81,959	34,854	6,769	2,800				
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	356,365	444,727	29,955	37,468				
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	88,989	82,488	7,119	6,599				
11	未決済取引	8	95	0	8				
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	1,250,740	1,088,345	100,059	87,067				
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	1,037,083	929,402	82,966	74,352				
14	うち、外部格付準拠方式適用分	196,459	141,736	15,716	11,338				
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—				
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	17,198	17,205	1,375	1,376				
16	マーケット・リスク	2,666,596	2,650,901	213,327	212,072				
17	うち、標準的方式適用分	1,059,405	1,100,180	84,752	88,014				
18	うち、内部モデル方式適用分	1,607,190	1,550,720	128,575	124,057				
19	オペレーショナル・リスク	4,104,922	3,816,213	328,393	305,297				
20	うち、基礎的手法適用分	897,054	863,199	71,764	69,055				
21	うち、粗利益配分手法適用分	—	—	—	—				
22	うち、先進的計測手法適用分	3,207,868	2,953,013	256,629	236,241				
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	2,355,212	2,204,656	199,683	186,899				
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	—	—	—	—				
24	フロア調整	538,051	183,267	43,044	14,661				
25	合計（スケーリングファクター適用後）	66,008,023	64,771,494	5,280,641	5,181,719				